

## <<风险值概论>>

### 图书基本信息

书名：<<风险值概论>>

13位ISBN编号：9787810496995

10位ISBN编号：7810496999

出版时间：2002-6

出版时间：上海财经大学出版社

作者：Cormac Butler

页数：328

字数：198

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<风险值概论>>

### 内容概要

风险值——在这其中的地位相当重要。

如果能够很好地掌握风险值的方法并充分理解衍生工具的独特性，那么你不仅可以更好地参与交易，而且还可以避免过去几年间许多大银行曾遭受过的损失。

本书主要内容包括前言、风险值概述、风险值在监管中的应用、投资组合的风险衡量、固定收益产品、复杂衍生产品风险的冒险、期权的风险敏感性、期权交易策略、蒙特卡罗模拟法、把风险值原则运用于信贷管理、如何估计变动变和降低风险、模型的实际应用等。

## <<风险值概论>>

### 作者简介

考马克·巴特勒 (Cormac Butler) 曾在中国香港、克罗地亚、波兰、爱沙尼亚、伦敦、都柏林等地担任过金融业务培训顾问，国际经验非常丰富。作为风险防范衍生工具交易方面的专家，他在许多著名的金融机构工作过，其中包括，所罗门兄弟银行、巴黎银行、联邦发展公司和爱尔兰联合银行。此外，他还担任过伦巴德 (Lombard) 风险管理系统 (即OBERON的生产商)、ABB以及阿拉伯银行公司的顾问。

考马克·巴特勒曾在注册会计师学院就职过，并且在投资管理与研究学院的交易员培训项目中分别担任过讲师。

考马克·巴特勒毕业于爱尔兰的利莫里克大学，取得了金融专业学位。他不仅有在商业银行工作的经验，而且还曾在库珀斯和里布兰德公司 (COOPERS&LYBRAND) 及皮特马维克 (PEAT MARWICK) 公司工作过。此外，他对期权和股票交易也有一定的操作经验。至今，他已经出版的著作有《国债交易风险管理》和《投资组合风险管理》。

## <<风险值概论>>

### 书籍目录

#### 前言

- 一、风险值概述
- 二、风险值在监管中的应用
- 三、投资组合的风险衡量
- 四、固定收益产品
- 五、复杂衍生产品风险的冒险
- 六、期权的风险敏感性
- 七、期权交易策略
- 八、蒙特卡罗模拟法
- 九、把风险值原则运用于信贷管理
- 十、如何估计变动变和降低风险
- 十一、模型的实际应用

<<风险值概论>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>